

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA						
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS						
MERC. COT. OFICIAIS DE BOLSA VAL. PORT.					6 824	1 194 274
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	467 263	102.25%	EUR	102.25%	322	478 112
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.38%	EUR	101.38%	6 503	716 163
						1 194 274
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					431 985	158 029 699
Títulos de Dívida Pública						
CCTS Float 06/2022	5 000 000	100.72%	EUR	100.72%	71	5 035 971
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	102.04%	EUR	102.04%	18 801	2 569 751
SAPGR Float 03/21	2 100 000	100.06%	EUR	100.06%		2 101 281
VW 1.375% 10/2023	500 000	103.44%	EUR	103.44%	1 450	518 640
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.60%	EUR	100.60%	1 017	504 032
VW 1.25% 08/2022	900 000	102.09%	EUR	102.09%	4 716	923 517
VW Float 02/2021	300 000	100.07%	EUR	100.07%	110	300 308
VW 0.5% 06/2022	350 000	100.79%	EUR	100.79%	935	353 707
MRKGR 0.005% 12/2023	800 000	100.47%	EUR	100.47%	2	803 762
EOANGR 0% 09/2022	1 500 000	100.46%	EUR	100.46%		1 506 960
EOANGR 0% 12/2023	650 000	100.43%	EUR	100.43%		652 808
PBBGR Float 07/28/23	2 300 000	100.30%	EUR	100.30%	1 624	2 308 409
PBBGR 0.625% 02/2022	700 000	100.36%	EUR	100.36%	3 741	706 261
BASGR 0.101% 06/2023	400 000	100.64%	EUR	100.64%	232	402 784
IFXGR 0.75% 06/2023	500 000	102.13%	EUR	102.13%	1 962	512 627
DB Float 05/2022	1 000 000	100.27%	EUR	100.27%	367	1 003 057
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	100.64%	EUR	100.64%	3 797	1 412 687
BNP Float 09/22	1 500 000	101.19%	EUR	101.19%	130	1 517 935
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.08%	EUR	101.08%	165	505 570
RENAULT Float 04/21	100 000	100.06%	EUR	100.06%	32	100 091
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.83%	EUR	100.83%	590	1 008 900
BNP Float 06/24	500 000	101.04%	EUR	101.04%	77	505 272
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.13%	EUR	100.13%	25	400 561
GFCFP Float 06/22	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%		1 003 110
RENAULT 0.75% 09/22	2 500 000	100.94%	EUR	100.94%	4 983	2 528 558
ACAFP Float 03/23	500 000	100.66%	EUR	100.66%	25	503 340
CAFP Float 06/22	2 000 000	100.22%	EUR	100.22%	73	2 004 413
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	100.44%	EUR	100.44%	1 304	2 010 164
ACAFP Float 01/2022	1 200 000	100.50%	EUR	100.50%	106	1 206 058
BFCM 0.125% 08/2021	1 500 000	100.37%	EUR	100.37%	637	1 506 187
MCFP 0% 02/2021	300 000	100.05%	EUR	100.05%		300 147
SOCGEN 0% 05/2022	500 000	100.42%	EUR	100.42%		502 085
VIVFP 0% 06/2022	1 400 000	100.33%	EUR	100.33%		1 404 578
BPCEGP Float 01/2023	500 000	100.34%	EUR	100.34%		501 715
CAFP Float 09/2023	400 000	100.41%	EUR	100.41%	21	401 653
DSYFP 0% 09/2022	700 000	100.38%	EUR	100.38%		702 688
RENAUL 0.25% 03/23	200 000	99.91%	EUR	99.91%	410	200 224
EFFP 0% 05/23	700 000	100.36%	EUR	100.36%		702 499
CAPFP 0.625% 06/2025	2 000 000	102.79%	EUR	102.79%	6 575	2 062 455
ALDFP 0.375% 10/2023	500 000	100.78%	EUR	100.78%	380	504 265

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
STANLN 3.625% 11/22	1 000 000	106.20%	EUR	106.20%	3 873	1 065 843
F 1.875% 06/2021	1 000 000	100.04%	EUR	100.04%	9 812	1 010 242
HSBC Float 09/22	130 000	100.40%	EUR	100.40%	2	130 525
CCE FLOAT 11/21	500 000	100.26%	EUR	100.26%		501 290
RBS Float 09/21	1 400 000	100.52%	EUR	100.52%	42	1 407 364
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	100.36%	EUR	100.36%	754	1 556 318
RBS Float 06/2021	350 000	100.25%	EUR	100.25%	25	350 900
GSK Float 09/2021	500 000	100.29%	EUR	100.29%	9	501 454
RBS Float 03/21	400 000	100.07%	EUR	100.07%	25	400 321
LLOYDS 0.375% 01/25	350 000	101.22%	EUR	101.22%	1 216	355 468
GSK 0.125% 05/2023	200 000	100.75%	EUR	100.75%	160	201 660
BACR 1.5% 09/2023	1 300 000	104.27%	EUR	104.27%	6 411	1 361 947
MRLSM 2.225% 04/23	2 000 000	104.30%	EUR	104.30%	30 601	2 116 561
SANSCF1% 05/21	1 400 000	100.53%	EUR	100.53%	8 438	1 415 858
SANTAN Float 03/22	800 000	100.97%	EUR	100.97%	117	807 893
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.52%	EUR	99.52%	17	497 607
CABKSM 1.125% 1/2023	2 700 000	102.23%	EUR	102.23%	29 462	2 789 753
SABSM 0.875% 03/2023	1 300 000	101.71%	EUR	101.71%	9 412	1 331 694
AMSSM Float 03/22	600 000	99.64%	EUR	99.64%		597 828
KUTXAB 0.5% 09/2024	200 000	101.86%	EUR	101.86%	268	203 986
SABSM 1.75% 06/2023	200 000	102.47%	EUR	102.47%	1 784	206 732
SWEDA 0.25% 11/22	3 000 000	100.82%	EUR	100.82%	1 130	3 025 760
VLVY 0.1% 05/2022	300 000	100.26%	EUR	100.26%	182	300 959
SWEDA 0.25% 10/2024	300 000	100.82%	EUR	100.82%	173	302 624
VLVY 0% 02/2023	400 000	100.14%	EUR	100.14%		400 564
VLVY 0,125% 09/2024	300 000	100.46%	EUR	100.46%	109	301 486
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.03%	EUR	101.03%	10 795	1 021 065
ISPIM Float 04/22	2 350 000	100.73%	EUR	100.73%	2 140	2 369 248
FCABNK Float 06/21	2 500 000	100.08%	EUR	100.08%		2 501 925
ACEIM Float 06223	900 000	100.04%	EUR	100.04%		900 324
FCABNK 0.625% 11/22	150 000	101.05%	EUR	101.05%	98	151 671
AZMIM 1.625% 12/2024	1 000 000	101.07%	EUR	101.07%	890	1 011 610
FCABNK 0.25% 02/2023	400 000	100.28%	EUR	100.28%	926	402 062
PG 2% 11/21	1 000 000	102.00%	EUR	102.00%	3 123	1 023 123
XYL 2.25% 03/23	1 000 000	104.47%	EUR	104.47%	18 247	1 062 897
C Float 05/21	3 000 000	100.31%	EUR	100.31%	956	3 010 136
MS Float 01/22	2 500 000	100.09%	EUR	100.09%	862	2 503 012
WFC Float 01/22	1 000 000	100.38%	EUR	100.38%		1 003 770
BAC Float 02/22	1 200 000	100.05%	EUR	100.05%	500	1 201 112
GS Float 09/22	1 500 000	100.25%	EUR	100.25%	92	1 503 827
PCLN 0.8% 03/22	1 000 000	100.99%	EUR	100.99%	6 510	1 016 430
BAC Float 05/23	1 000 000	100.62%	EUR	100.62%	419	1 006 659
GM Float 05/21	1 800 000	100.03%	EUR	100.03%	434	1 800 902
GE 0.375% 05/22	3 500 000	100.60%	EUR	100.60%	8 235	3 529 130
C Float 03/23	1 000 000	100.54%	EUR	100.54%		1 005 380
MS Float 05/21	500 000	100.18%	EUR	100.18%		500 900
PG 0.625% 10/2024	2 000 000	103.21%	EUR	103.21%	2 158	2 066 278
T Float 09/23	1 500 000	101.31%	EUR	101.31%	380	1 520 075
EMR 0.375% 05/2024	400 000	101.76%	EUR	101.76%	921	407 945
HOG 0.9% 11/19/24	250 000	101.35%	EUR	101.35%	265	253 635
FIS 0.125% 12/2022	700 000	100.48%	EUR	100.48%	70	703 451
FIS Float 05/2021	1 500 000	100.07%	EUR	100.07%		1 501 095

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
CB 0.3% 12/2024	800 000	101.31%	EUR	101.31%	112	810 616
GS Float 04/2023	1 000 000	100.20%	EUR	100.20%	82	1 002 072
F 1.744% 07/2024	800 000	99.29%	EUR	99.29%	6 345	800 625
HON 0% 03/2024	300 000	100.41%	EUR	100.41%		301 239
BRK 0% 03/2025	500 000	100.49%	EUR	100.49%		502 440
UBS Float 04/2021	900 000	100.11%	EUR	100.11%		900 999
SCANIA Float 03/21	1 100 000	100.04%	EUR	100.04%		1 100 418
EDPPL 2.375% 03/23	2 000 000	105.56%	EUR	105.56%	36 959	2 148 219
DAIGR Float 05/22	1 500 000	100.19%	EUR	100.19%		1 502 790
NIBCAP 1.5% 01/22	1 000 000	101.74%	EUR	101.74%	13 770	1 031 160
DAIGR Float 01/23	1 000 000	100.11%	EUR	100.11%		1 001 060
LPTY Float 01/21	200 000	100.00%	EUR	100.00%		200 006
ADNA Float 03/21	200 000	100.04%	EUR	100.04%		200 088
NIBCAP 1.125% 04/23	1 000 000	102.52%	EUR	102.52%	7 921	1 033 121
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.29%	EUR	100.29%	0	300 882
INTNED Float 09/23	1 000 000	101.56%	EUR	101.56%	94	1 015 664
TOYOTA 0.25% 01/2022	2 100 000	100.53%	EUR	100.53%	5 121	2 116 251
ABNANV 0.875% 01/24	1 000 000	103.21%	EUR	103.21%	8 415	1 040 535
BMW 0.625% 10/2023	2 000 000	102.07%	EUR	102.07%	2 979	2 044 279
ANNGR Float 12/2022	2 000 000	100.32%	EUR	100.32%		2 006 340
NIBCAP 0.875% 07/25	400 000	102.32%	EUR	102.32%	1 697	410 981
ENELIM 0% 06/2024	700 000	100.39%	EUR	100.39%		702 730
ALVGR 0% 01/2025	1 300 000	101.16%	EUR	101.16%		1 315 106
DLR 0.125% 10/2022	300 000	100.34%	EUR	100.34%	80	301 100
REPSM 0.125% 10/2024	1 000 000	100.56%	EUR	100.56%	301	1 005 881
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	100.30%	EUR	100.30%	3 288	1 006 278
NYKRE Float 06/22	2 000 000	100.40%	EUR	100.40%	73	2 008 133
DANBNK 1,375% 05/23	2 000 000	101.73%	EUR	101.73%	15 726	2 050 306
JYBC 0.375% 10/2025	1 250 000	100.46%	EUR	100.46%	1 002	1 256 727
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	102.36%	EUR	102.36%	5 610	1 541 040
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	100.28%	EUR	100.28%		1 905 320
SCBNOR 0.875% 01/22	200 000	101.11%	EUR	101.11%	1 654	203 878
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.06%	EUR	100.06%		600 372
KBCBB 0.75% 10/23	1 500 000	102.48%	EUR	102.48%	2 312	1 539 497
KBCBB Float 11/22	500 000	100.63%	EUR	100.63%	12	503 177
KBCBB 1.125% 01/2024	400 000	103.62%	EUR	103.62%	4 205	418 701
CCBGBB 0.01% 10/2025	600 000	100.16%	EUR	100.16%	13	600 955
RBIAS 6% 10/2023	1 000 000	116.34%	EUR	116.34%	12 658	1 176 098
RBIAS 0.25% 01/2025	2 100 000	101.06%	EUR	101.06%	4 949	2 127 146
DLTAS 2008-1 A	502 828	99.78%	EUR	99.78%		501 722
GLENLN 1.625% 01/22	1 500 000	101.27%	EUR	101.27%	23 243	1 542 323
GLENLN 1.875% 09/23	300 000	104.36%	EUR	104.36%	1 695	314 769
DHR Float 06/22	1 000 000	100.19%	EUR	100.19%		1 001 890
BDX 0.174% 06/2021	1 000 000	100.06%	EUR	100.06%	1 006	1 001 646
NESNVX 0% 12/2025	800 000	101.08%	EUR	101.08%		808 672
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.44%	EUR	100.44%		1 506 555
MUFG 0.98% 10/2023	1 000 000	103.08%	EUR	103.08%	2 255	1 033 035
MUFG 0.339% 07/2024	200 000	101.28%	EUR	101.28%	308	202 866
MIZUHO 0.214% 10/25	200 000	101.07%	EUR	101.07%	101	202 233
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.75%	EUR	100.75%	249	1 007 719
CEZCP 4.875% 04/2025	900 000	119.99%	EUR	119.99%	31 253	1 111 190

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ISLBAN 1.125% 04/22	1 400 000	101.31%	EUR	101.31%	11 392	1 429 732
ETISLT 1.75% 06/2021	900 000	100.91%	EUR	100.91%	8 501	916 718
BACR Float 03/2021	900 000	99.45%	EUR	99.45%		895 086
WFC Float 04/21	1 000 000	100.18%	EUR	100.18%	203	1 001 983
						152 993 728
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					40 475	16 752 140
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	101.17%	EUR	101.17%	4 671	2 028 071
K 1.75% 05/2021	1 500 000	100.56%	EUR	100.56%	10 644	1 519 044
AMGN 1.25% 02/22	900 000	101.30%	EUR	101.30%	9 559	921 232
F Float 12/21	819 000	98.69%	EUR	98.69%		808 304
F Float 05/21	300 000	99.34%	EUR	99.34%		298 005
FDX 0.7% 05/2022	1 500 000	101.12%	EUR	101.12%	6 703	1 523 458
KO Float 03/2021	400 000	100.06%	EUR	100.06%		400 256
UBS Float 09/22	1 000 000	100.39%	EUR	100.39%	49	1 003 959
ABT 0.875% 09/2023	1 500 000	102.96%	EUR	102.96%	3 452	1 547 897
MDT Float 03/2021	2 150 000	100.07%	EUR	100.07%		2 151 398
MDT 0% 03/2023	1 500 000	100.41%	EUR	100.41%		1 506 210
TACHEM Float 11/22	1 500 000	101.43%	EUR	101.43%	979	1 522 444
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	101.16%	EUR	101.16%	4 418	1 521 863
						16 752 140
						175 976 113
OUTROS VALORES						
VAL. MOBILIÁRIOS NACIONAIS NÃO COTADOS					28	21 575
Obrigações diversas						
VERSE 4 SNR 02/2021	21 503	100.21%	EUR	100.21%	28	21 575
OUTROS INSTRUMENTOS DE DÍVIDA					29 243	9 622 405
Papel Comercial						
PC ECP ANA 11/09 181D 0.1000% 2020-09-11 a 2021-03-11			EUR		342	1 099 789
PC ECP JMS 16NOV 63D 0.5000% 2020-11-16 a 2021-01-18			EUR		126	199 953
PC ECP CIE 13NOV 94D 0.4000% 2020-11-13 a 2021-02-15			EUR		870	1 599 201
PC P.C. UNILEVER 7ª EMI 0.0000% 2020-12-09 a 2021-01-11			EUR			600 000
PC ECP JMS 14/09 126D 1.1000% 2020-09-14 a 2021-01-18			EUR		655	199 898
PC P.C. GLINTT 19ªEM. 2.8000% 2020-10-08 a 2021-01-11			EUR		4 628	704 628
PC ECP JMS 14/10 187D 1.2000% 2020-10-14 a 2021-04-19			EUR		258	99 647
PC ECP JMS 16NOV 120D 0.7000% 2020-11-16 a 2021-03-16			EUR		176	199 717
PC ECP JMS 16/12 182D 0.8500% 2020-12-16 a 2021-06-16			EUR		111	298 845
PC P.C.GLINTT 20ª EM. 2.8000% 2020-10-13 a 2021-02-10			EUR		6 844	1 106 844
PC ECP JMS 14/10 96D 0.9000% 2020-10-14 a 2021-01-18			EUR		777	399 833
PC PC EDA 263 23/11 60 0.0000% 2020-11-23 a 2021-01-22			EUR			700 000
PC P.C.VISABEIRA 35ªEM 3.0000% 2020-09-30 a 2021-01-08			EUR		8 525	1 108 525
PC P.C.VISABEIRA 37ªEM 2.8500% 2020-10-19 a 2021-02-12			EUR		5 858	1 005 858
PC ECP JMS 16/12 90D 0.5500% 2020-12-16 a 2021-03-16			EUR		72	299 666
						9 622 405
						9 643 980
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						9 481 310
Fundimo	1 205 093	7.87	EUR	7.87		9 481 310

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LIQUIDEZ						
À VISTA						5 959 176
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			4 754 647
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			222 840
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			950 772
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			30 917
						5 959 176
						5 959 176
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						90 562
VALORES PASSIVOS						-674 876
						-584 314
						200 476 265
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
OEH1 EUR EUX 03/21	-80	135.18	EUR	135.18		-10 814 400
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						
					33 926 917.16	
Valor da Unidade de Participação: € 5.9091						